

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 506	Finansal Ekonometri	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Ekonometrik yöntemlerin finansal alanda uygulanması ve finansal modellemeler yapmak.
İçerik	Doğrusal Ekonometrik Modeller Zaman serileri analizi Yapısal kırılma ARCH-GARCH modelleri
Kaynaklar	Wooldridge, "Introduction to econometrics".

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Finansal Ekonometriye Giriş
2	Doğrusal Modellerde OLS yöntemi
3	Gauss Markov Teoremi ve Varsayım testleri: Dizi testi, otokorelasyon testleri, varyans eşitliği testi
4	Varsayım Testleri (devam)
5	Stata Uygulaması
6	Zaman serileri analizi: grafiksel analiz, korelogram analizi, birim kök testleri
7	Stata Uygulaması
8	Ödev sunumu
9	Ödev sunumu
10	Yapısal Kırılma: Kukla değişkenlerle yapısal kırılma modellemesi
11	Yapısal Kırılma: Chow testi, Cusum ve Cusum-Square testleri
12	Stata Uygulaması
13	Heterosedastik modeller: ARCH-GARCH modelleri
14	Stata Uygulaması